

淡江大學 104 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等應用計量	授課 教師	洪瑞成 HUNG,JUI-CHENG
	ADVANCE APPLIED ECONOMETRICS		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。 B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。 C. 熟稔相關財金研究方法與成果。 D. 具備獨立研究的學術能力。 E. 提升學生的教學能力。 F. 提升學術研究國際化之能力。			
課程簡介	本課程的目的在於訓練學生具有財務金融研究的基本能力，其分為資料的認識與取得，以及相關研究方法，其包括基本統計分析、統計檢定、回歸分析、進階迴歸分析、虛擬變數的應用、時間序列分析方法、向量自我回歸、GARCH模型等。另外，對於與波動率估計相關的財務應用，本課程也將教授學生相關的實證議題。		
	The objective of this course aims at training students to have basic ability of financial research, including data identification, collecting, analysis, and the related financial econometric methods. The contents of this course contain basic statistics analysis, statistical testing, regression analysis, advanced regression analysis, dummy variable application, time series analysis, vector autoregression and GARCH model. Moreover, this course also introduces some empirical finance research issues related to volatility estimation for students.		

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系(所)核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。
(例如：「系(所)核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列。)

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系(所)核心能力
1	本課程將介紹與財務金融研究相關的計量方法與實際應用。主要目的是使這門課程的學生有能力進行實證研究，以及理解實證分析。	This course introduces financial econometrics and practical applications related to financial research. The teaching goal is to make students to have ability of doing academic research and comprehend empirical analysis.	P3	CD

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	本課程將介紹與財務金融研究相關的計量方法與實際應用。主要目的是使這門課程的學生有能力進行實證研究，以及理解實證分析。	講述、討論、實作	實作、報告、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◇ 全球視野	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◆ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◇ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	104/09/14~ 104/09/20	財務計量導論與課程介紹(本課程使用之計量軟體)	
2	104/09/21~ 104/09/27	假設檢定與應用	
3	104/09/28~ 104/10/04	簡單線性回歸與殘差檢定	
4	104/10/05~ 104/10/11	市場模型：簡單回歸之應用	
5	104/10/12~ 104/10/18	單根檢定	
6	104/10/19~ 104/10/25	共整合檢定	
7	104/10/26~ 104/11/01	期中報告I	
8	104/11/02~ 104/11/08	期中報告II	
9	104/11/09~ 104/11/15	ARMA模型	
10	104/11/16~ 104/11/22	ARMA模型之應用	
11	104/11/23~ 104/11/29	VAR模型	
12	104/11/30~ 104/12/06	VECM模型	

13	104/12/07~ 104/12/13	單變量GARCH家族模型	
14	104/12/14~ 104/12/20	多變量GARCH家族模型	
15	104/12/21~ 104/12/27	財務實證研討I	
16	104/12/28~ 105/01/03	財務實證研討II	
17	105/01/04~ 105/01/10	期末報告I	
18	105/01/11~ 105/01/17	期末報告II	
修課應 注意事項		上課請攜帶筆電	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		計量經濟及高等研究方法-JMulti與Eviews的應用，張紹勳著，五南書局。	
參考書籍		財務計量：with Gretl 1/e 楊奕農 指南書局 時間序列分析：經濟與財務上之應用，楊奕農 - 雙葉書廊 財務計量：with Gretl 1/e 楊奕農 指南書局	
批改作業 篇數		篇（本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫）	
學期成績 計算方式		◆出席率： 20.0 % ◆平時評量：20.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈 〉： %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」進入。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。	